

大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资 基金清算报告

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年3月6日

清算报告公告日：2024年3月7日

一、重要提示

大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]第3286号《关于准予大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准，由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。于2021年2月9日成立并正式运作，本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金已触发基金合同终止情形，基金管理人应当在终止情形出现后终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会。《基金合同》生效后，如在本基金某一开放期最后一日日终出现如下情形之一的，基金管理人可以在履行信息披露义务后将本基金与其他基金合并或终止基金合同，而无需召开基金份额持有人大会：1、当日基金资产净值加上当日净申购金额或者减去当日净赎回金额后低于5000万元；2、基金份额持有人数量少于200人。”本基金最近一个开放期为2024年1月15日至2024年2月19日。截至2024年2月19日，本基金当日基金资产净值加上当日净申购金额或者减去当日净赎回金额后低于5000万元，已出现触发基金合同终止的上述情形。基金管理人将终止《基金合同》并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。

本基金自2024年2月20日起进入清算期，由基金管理人大成基金管理有限公司、基金托管人北京银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2024年2月20日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金基本情况

基金名称	大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	大成恒享春晓一年定开混合	
基金主代码	011075	
交易代码	011075	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2021年2月9日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
基金最后运作日（2024年2月19日）基金份额总额	19,400,864.63份	
下属分级基金的基金简称	大成恒享春晓一年定开混合 A	大成恒享春晓一年定开混合 C
下属分级基金的交易代码	011075	011076
基金最后运作日（2024年2月19日）下属分级基金份额总额	19,236,527.94份	164,336.69份

2、基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>一、封闭期投资策略 本基金将采用“自上而下”的资产配置策略，在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等宏观因素的基础上，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在个券投资方面采用“自下而上”精选策略，通过严谨个股选择、信用分析以及对券种收益水平、流动性的客观判断，综合运用多种投资策略，精选个券构建投资组合。</p> <p>二、开放期投资策略 开放期内，为了保证组合具有较高的流动性，方便投资人安排投资，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，主要投资于具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中证综合债券指数收益率*75%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

三、财务会计报告

资产负债表(已经审计)

会计主体：大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2024年2月19日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024 年 2 月 19 日
资产：	
货币资金	18,440,164.47
结算备付金	27,894.19
存出保证金	12,575.56
交易性金融资产	383,103.18
债券投资	383,103.18
资产总计	18,863,737.40
负债和净资产	最后运作日 2024 年 2 月 19 日
负债：	
应付赎回款	999,744.60
应付管理人报酬	8,588.41
应付托管费	2,147.11
应付销售服务费	59.94
应交税费	2.98
其他负债	181,929.64
负债合计	1,192,472.68
净资产：	
实收基金	19,400,864.63
未分配利润	-1,729,599.91
净资产合计	17,671,264.72
负债和净资产总计	18,863,737.40

注：最后运作日 2024 年 2 月 19 日，基金份额总额 19,400,864.63 份，其中大成恒享春晓一年定开 A 类基金份额 19,236,527.94 份，基金份额净值 0.9109 元；大成恒享春晓一年定开 C 类基金份额 164,336.69 份，基金份额净值 0.9031 元。

四、基金财产分配

自 2024 年 2 月 20 日至 2024 年 3 月 6 日止为清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 18,440,164.47 元，其中银行托管户余额 18,432,757.86 元，应计利息 7,406.61 元。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 27,894.19 元。其中上交所最低结算备付金余额 10,154.00 元，上交所最低备付金应计利息 21.80 元，深交所最低结算备付金余额 17,691.32 元，深交所最低备付金应计利息 27.07 元。
- (3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 12,575.56 元。其中上交所存出保证金账户余额 4,597.60 元，上交所存出保证金应计利息 7.78 元，深交所存出保证金账户余额 7,959.40 元，深交所存出保证金应计利息 10.78 元。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产均为债券投资，债券市值为人民币 383,103.18 元。本基金持有的交易性金融资产已于 2024 年 2 月 21 日卖出变现，总计变现金额为人民币 383,905.90 元。

2、负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付赎回款 999,744.60 元，已于 2024 年 2 月 20 日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 8,588.41 元，该款项将于清算期间结束后支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,147.11 元，该款项将于清算期间结束后支付。
- (4) 本基金最后运作日应付应付销售服务费为人民币 59.94 元，该款项将于清算期间结束后支付。
- (5) 本基金最后运作日应交税费为人民币 2.98 元，该款项将于清算期间结束后支付。
- (6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 181,929.64 元。其中应付中债登账户维护费 4,500.00 元，已于 2024 年 2 月 26 日支付。应付上清所账户维护费 4,800.00 元，已于 2024 年 2 月 28 日支付。应付交易费用为 20,799.14 元，应付信息披露费 86,830.50 元，应付审计费 65,000.00 元，款项将于清算期间结束后支付。

3、清算期间损益情况

单位：人民币元

清算期间损益情况	
项目	
一、清算期间收入（损失以“-”填列）	
利息收入	2,437.30
其中：存款利息收入（注 1）	2,437.30
处置交易性金融资产产生的净收益（注 2）	802.44
清算期间收入小计①	3,239.74
二、清算期间费用	
税金及附加（注 3）	0.04
中债登账户维护费（注 4）	-1,500.00
上清所账户维护费（注 5）	-1,600.00
汇划费（注 6）	362.85
清算期间费用小计②	-2,737.11
三、清算期间净收益①-②	5,976.85

注1：利息收入系计提的自2024年2月20日起至2024年3月6日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

注2：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出交易性金融资产的成交金额减去交易费用及交易性金融资产最后运作日的估值总额后的差额。

注3：处置交易性金融资产产生的税费，该款项将于清算期间结束后支付。

注4、5：根据实际产生的费用调整。

注6：汇划费系自2024年2月20日起至2024年3月6日止清算期间支付的划款费用及清算期结束后需要支付的划款费用。

4、资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位：人民币元

项目	大成恒享春晓一年定开混合 A 基金份额	大成恒享春晓一年定开混合 C 基金份额
一、最后运作日 (2024年2月19日) 基金净资产	17,522,844.12	148,420.60
加：清算期间净收益	5,950.55	26.30
减：最后运作日申请的 赎回款	2,346,655.15	81,403.47
二、清算期结束日 (2024年3月6日) 基金净资产	15,182,139.52	67,043.43

注：(1)资产处置及负债清偿后，于2024年3月6日本基金剩余财产为人民币15,249,182.95元，根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(2)2024年3月6日至清算款划出日前一日的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算。基金管理人垫付的资金（如有）以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告中的主要财务指标（三、财务会计报告；四、基金财产分配）已经由基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

五、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1)《大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《关于〈大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金清算报告〉的法律意见》

2、存放地点

基金管理人的住所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

大成恒享春晓一年定期开放混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年3月7日